

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年10月1日(木)

短期市場の推移

	9月25日	9月28日	9月29日	9月30日
加重平均金利	▲0.030	▲0.032	▲0.031	▲0.061
東京レポレート(ON)	▲0.101	▲0.094	▲0.103	▲0.102
無コール残	120,757	109,736	117,692	80,838
ON	77,414	69,073	78,569	60,625
その他	43,343	40,663	39,123	20,213
有コール残	23,014	22,158	20,897	20,473

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

10月2日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想	
8:30	8月有効求人倍率	1.05倍	21:30	(米)9月非農業部門雇用者数	90.0万人
8:30	8月失業率	+3.0%	21:30	(米)9月失業率	8.2%
	-	-	21:30	(米)9月平均時給[前年比]	4.8%

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.070	0.001	▲0.031	▲0.087
T/N	▲0.030	▲0.001	▲0.011	▲0.081
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.030	0.000	▲0.021	▲0.087
2W	▲0.035	0.010	▲0.019	▲0.093
3W	-	-	0.010	▲0.100
1M	▲0.045	0.480	▲0.021	▲0.108
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.128
6M	-	-	-	▲0.144
1Y	-	-	-	▲0.164

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.035%の出合から始まり、その後は主に▲0.045%~▲0.025%の水準で出合が見られた。月末で調達を控えていた先が戻り、同加重平均金利(速報)は前営業日対比+0.030%の▲0.031%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.050 ~ ▲0.035	▲0.035 ~ ▲0.030	▲0.040 ~ ▲0.015

翌営業日のマーケット

引き続き地銀中心の出合となり、出合水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	10月1日	10月2日	10月5日
券	▲1,000	▲100	+1,000
財政	▲30,100	▲70,900	▲30,000
過不足	▲31,100	▲71,000	▲29,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+4,600	
共通担保(全店)			▲3,800
CP等買入	▲300	▲300	
ETF買入	+800	+200	
国債補完供給	+2,400	+300	
米ドル資金供給用担保国債供給	▲300	+1,600	
当座預金増減	▲23,900	▲69,200	▲32,800
当座預金残高	4,850,700	4,781,500	4,748,700
準備預金残高	4,232,100	主な需給要因	
積み終了先	4,232,100	国債発行(10年)	国庫短期証券発行・償還(3M)
超過準備	4,232,100	税保険揚げ	
非準備先残高	618,600		
準備預金進捗率	99.9%		
平均	53.3%		
乖離率	46.6%		

10月1日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債補完供給(10/1~10/2)	328	328	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]
9月30日時点 6,060,300

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,409,900
10月2日以降の残り所要積数 200
平均 0

国庫短期証券入札予定

10月2日	3ヶ月	第941回
10月8日	6ヶ月	第942回
10月9日	3ヶ月	
10月16日	3ヶ月	
10月6日	30年	
10月8日	5年	
10月20日	20年	
10月27日	2年	

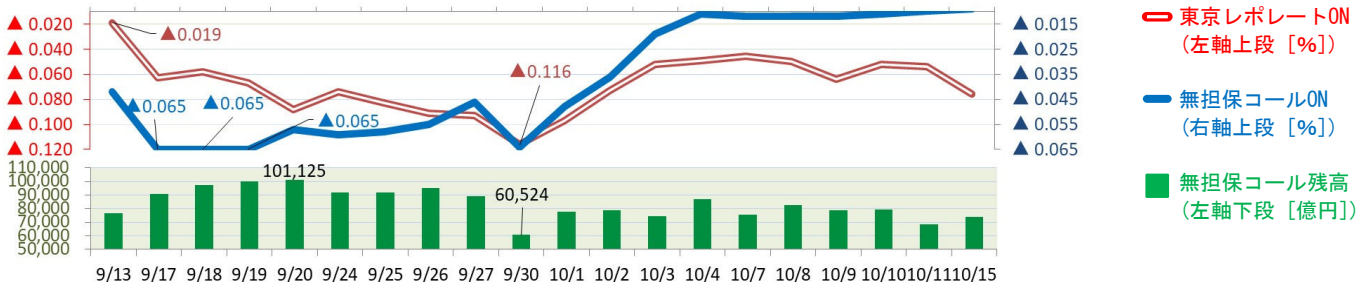
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	500~1,500	1,000	月3回程度	9月30日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 26 30	9月28日	6
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 14 21 23 30	9月30日	6
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	5 9 14 21 30	9月28日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 26	9月14日	2
25年超	0~500	300	9 26	9月28日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	9月28日	2
変動利付債<偶数月>	500	1,000	月1回	8月5日	1

1年前の市場推移

○2019年9月積み期 [9月13日~10月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会